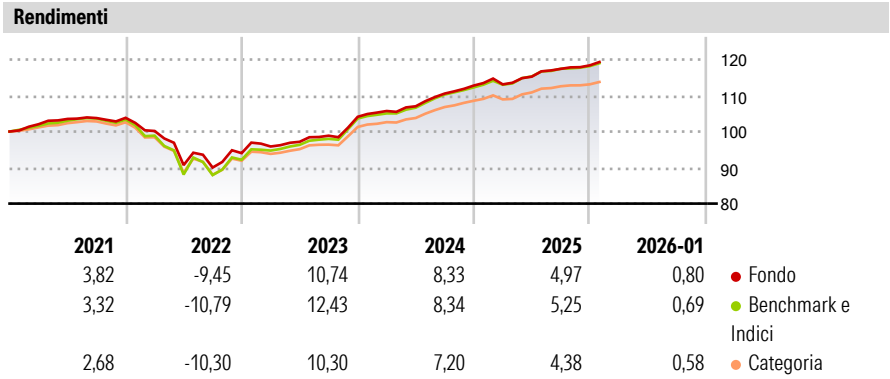


BlueBay Funds - BlueBay High Yield ESG Bond Fund S - EUR

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Obbligazionari High Yield EUR	Morningstar Eurozone High-Yield Bond GR EUR Usato nel Report	ICE BofA Euran Ccy HY Constnd TR HEUR	★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Conseguire un rendimento totale superiore a quello dell'indice Merrill Lynch European Currency High Yield Constrained Index, investendo in un portafoglio di titoli a reddito fisso. Il Comparto investe almeno due terzi del patrimonio netto in titoli a reddito fisso con rating inferiore a investment grade. Il Comparto può investire fino un terzo del patrimonio netto in titoli a reddito fisso con rating investment grade. Di norma, almeno il 50% del suo patrimonio netto sarà investito in titoli a reddito fisso* emessi da entità domiciliate in paesi europei i cui titoli di stato a lungo termine abbiano un rating investment grade ovvero da entità domiciliate altrove, a condizione che l'emittente abbia una società capogruppo domiciliata in un...



Misure di Rischio			
3Y Alpha	-0,78	3Y Sharpe Ratio	1,47
3Y Beta	1,05	3Y Std Dev	2,79
3Y R-Squared	95,23	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,97	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	0,61	10Y Risk	-Med

Basati su Morningstar Eurozone High-Yield Bond GR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,51	1,53	1,16	2026	-	-	-	-
6-Mesi	2,26	2,06	1,66	2025	0,30	1,89	1,88	0,82
1-Anno	4,88	5,06	4,15	2024	1,55	1,23	3,31	2,01
3-Anni Ann.ti	6,77	7,47	6,40	2023	1,97	1,37	1,73	5,31
5-Anni Ann.ti	3,34	3,30	2,66	2022	-3,52	-9,46	-0,76	4,45
10-Anni Ann.ti	4,76	4,49	3,73					

Rendimenti aggiornati al 09/02/2026

Portafoglio 31/12/2025



Fixed Income Style Box™	Fondo	Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
Duration Effettiva	-	AAA	0,00	BBB	2,86
Maturity effettiva	4,30	AA	0,00	BB	48,33
Qualità Credito Media	B	A	0,00	B	40,19
				Below B	8,62
				Not Rated	0,00

Titoli principali		
Nome	Settore	%
Euro Schatz Future Mar 26	—	15,10
Euro Bobl Future Mar 26	—	2,35
Sunrise Finco I B.V 4.625%	—	1,89
Fibercop S.p.A. 4.75%	—	1,80
Softbank Group Corp. 5%	—	1,40
Grifols S.A. 3.875%	—	1,38
Teva Pharmaceutical Finance...	—	1,36
Softbank Group Corp. 5.25%	—	1,35
Adler Financing S.a r.l. 8.25%	—	1,14
Pinnacle Bidco PLC 10%	—	1,13
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		28,91
Numero Complessivo di Titoli Azionari		5
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		232

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo	Scadenze %	Fondo
Governativo	14,61	da 1 a 3	13,52
Societario	95,20	da 3 a 5	31,83
Cartolarizzazioni	0,00	da 5 a 7	30,94
Enti Locali	0,00	da 7 a 10	4,04
Liquidità ed equivalenti	6,52	da 10 a 15	0,50
Derivati	-16,33	da 15 a 20	0,00
		da 20 a 30	0,65
		oltre 30	1,43
Coupon Range %	Fondo		
0 coupon	0,00		
Da 0 a 4 cedole	14,17		
Da 4 a 6 cedole	52,92		
Da 6 a 8 cedole	19,92		
Da 8 a 10 cedole	11,74		
Da 10 a 12 cedole	1,14		
Oltre 12 cedole	0,10		

Anagrafica

Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	20,59 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bluebayinvest.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	0,66%
Data di Partenza	05/11/2013	UCITS	Si	Spese correnti	0,66%
Nome del Gestore	Tim Leary	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
	Sid Chhabra	ISIN	LU0968472117		
	Tim van der Weyden				
Data Inizio Gestione	01/03/2022				
NAV (09/02/2026)	EUR 164,88				

BlueBay Funds - BlueBay High Yield ESG Bond Fund S - EUR

Patrimonio Netto (Mln)	455,49 EUR
(31/12/2025)	